



短期市場の推移

	9月24日	9月27日	9月28日	9月29日
加重平均金利	▲0.022	▲0.024	▲0.025	▲0.025
東京レポレート(TN)	▲0.091	▲0.095	▲0.095	▲0.108
無コール残	165,371	166,222	163,865	149,834
ON	81,428	81,079	75,962	62,111
その他	83,943	85,143	87,903	87,723
有コール残	17,563	17,271	17,356	18,271

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表
※加重平均金利は無担保コールONのもの、無・有コール残は無担保・有担保コール残高の意。

本日の短期市場金利 [%]

	無担保コール(速報)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.080	0.001	▲0.049	▲0.132
T/N	-	-	▲0.001	▲0.082
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	▲0.001	▲0.004	▲0.087
2W	▲0.020	▲0.003	▲0.016	▲0.090
3W	-	-	-	▲0.095
1M	▲0.040	▲0.001	▲0.030	▲0.098
2M	▲0.008	▲0.001	▲0.006	-
3M	-	-	-	▲0.109
6M	-	-	-	▲0.120
1Y	-	-	-	▲0.130

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

資金需給	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月30日		10月1日		10月4日	
券	▲300		+100		+1,000	
財政	▲8,500		▲21,400		▲40,000	
過不足	▲8,800		▲21,300		▲39,000	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
国債買入	+9,500					
CP等買入	▲5,800		+5,000			
国債補完供給	+100		+1,300			
当座預金増減	▲1,300		▲20,000		▲39,000	
当座預金残高	5,416,700		5,396,700		5,357,700	
準備預金残高	4,806,100		4,806,100		4,806,100	
積み終了先	4,806,100		4,806,100		4,806,100	
超過準備	4,804,400		4,804,400		4,804,400	
非準備先残高	610,600		610,600		610,600	
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%	
平均	50.0%		50.0%		50.0%	
乖離率	49.9%		49.9%		49.9%	

[億円]

9月30日のオペ結果

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国債補完供給(9/30~10/1)

1,250 1,250 ▲0.350 ▲0.350

2 2 ▲0.350 ▲0.350

マネタリーベース [億円]

9月29日時点 6,636,000

所要

今積期の所要準備額 3,615,500

10月1日以降の残り所要

積数 200

平均 0

国庫短期証券入札予定

10月1日	3ヶ月(第1027回)
10月7日	6ヶ月(第1028回)
10月8日	3ヶ月
10月15日	3ヶ月

国債入札予定

10月5日	10年
10月12日	30年
10月14日	5年
10月19日	20年

来月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオファー金額	直近オファー額	オファー予定日				直近日	残り回数
1年以下	1500	1,500	月1回				9月8日	1
1年超3年以下	4500	4,500	4	8	13	20	9月24日	4
3年超5年以下	4500	4,500	4	8	20	26	9月29日	4
5年超10年以下	4250	4,250	8	13	20	26	9月29日	4
10年超25年以下	1500	1,500	4				9月3日	1
25年超	500	500	20				9月24日	1
物価連動債	600	600	月1回				9月29日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回				7月7日	1

1年前の市場推移

○2020年9月積み期 [9月16日~10月15日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



本資料は投資環境等に関する情報提供を目的として作成したものです。本資料は投資勧誘を目的とするものではありません。有価証券等の取引には、リスクが伴います。投資についての最終決定は、投資家ご自身の判断と責任においてなされるようお願いいたします。当社は、いかなる投資の妥当性についても保証するものではありません。記載された意見や予測等は作成時点のものであり、正確性、完全性を保証するものではなく、今後予告なく変更されることがあります。

上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会